【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年11月25日
【計算期間】	第8期中（自　平成26年2月26日　至　平成26年8月25日）
【ファンド名】	ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンド ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンド ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンド
【発行者名】	ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　西　惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目３番１号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内三丁目３番１号
【電話番号】	03-3287-3110
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

１【ファンドの運用状況】

（１）【投資状況】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		3,702,751,475	97.00
	内　日本	3,702,751,475	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		114,539,956	3.00
純資産総額		3,817,291,431	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		6,862,890,637	96.99
	内　日本	6,862,890,637	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		212,737,357	3.01
純資産総額		7,075,627,994	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		4,126,654,831	96.99
	内　日本	4,126,654,831	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		127,895,915	3.01
純資産総額		4,254,550,746	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		315,095,894,410	98.63
	内　日本	315,095,894,410	98.63
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,363,803,417	1.37
純資産総額		319,459,697,827	100.00

その他資産の投資状況

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		4,466,000,000	1.40
	内　日本	4,466,000,000	1.40

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		351,267,708,600	80.31
	内　日本	351,267,708,600	80.31
地方債証券		29,756,868,719	6.80
	内　日本	29,756,868,719	6.80
特殊債券		29,045,981,091	6.64
	内　日本	29,045,981,091	6.64
社債券		24,820,931,100	5.67
	内　日本	24,511,611,100	5.60
	内　アメリカ	309,320,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,511,898,583	0.57
純資産総額		437,403,388,093	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		301,121,295,461	97.02
	内　アメリカ	173,675,785,742	55.96
	内　イギリス	27,141,483,767	8.74
	内　カナダ	14,643,986,317	4.72
	内　スイス	13,077,625,546	4.21
	内　フランス	12,042,615,694	3.88
	内　ドイツ	11,688,891,784	3.77
	内　オーストラリア	10,107,279,897	3.26
	内　オランダ	4,948,168,380	1.59
	内　スペイン	4,787,947,455	1.54
	内　スウェーデン	3,931,622,518	1.27
	内　香港	3,468,469,603	1.12
	内　アイルランド	3,434,900,634	1.11
	内　イタリア	3,107,390,676	1.00
	内　ジャージィー	2,030,926,685	0.65
	内　シンガポール	2,014,190,082	0.65
	内　デンマーク	1,999,801,811	0.64
	内　ベルギー	1,631,174,679	0.53

	内　オランダ領キュラソー	1,425,665,656	0.46
	内　フィンランド	1,157,026,859	0.37
	内　バミューダ	1,044,599,567	0.34
	内　ノルウェー	959,942,125	0.31
	内　イスラエル	691,218,232	0.22
	内　ルクセンブルグ	529,707,894	0.17
	内　ケイマン諸島	334,184,395	0.11
	内　オーストリア	277,748,270	0.09
	内　ポルトガル	249,997,668	0.08
	内　イギリス領バージン諸島	161,420,477	0.05
	内　ニュージーランド	159,167,140	0.05
	内　パナマ	146,756,557	0.05
	内　リベリア	107,242,503	0.03
	内　ガーンジィ	64,166,291	0.02
	内　マン島	59,726,089	0.02
	内　モーリシャス	20,464,468	0.01
投資信託受益証券		943,448,519	0.30
	内　オーストラリア	806,630,274	0.26
	内　シンガポール	136,818,245	0.04
投資証券		5,962,065,905	1.92
	内　アメリカ	4,899,132,625	1.58
	内　イギリス	422,380,740	0.14
	内　フランス	388,575,958	0.13
	内　香港	146,413,995	0.05
	内　カナダ	62,473,731	0.02
	内　オランダ	43,088,856	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,348,466,246	0.76
純資産総額		310,375,276,131	100.00

その他資産の投資状況

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		606,134,000	△0.20
	―	606,134,000	△0.20
株価指数先物取引（買建）		2,098,583,822	0.68
	内　アメリカ	1,346,394,777	0.43
	内　ドイツ	397,840,310	0.13
	内　イギリス	187,346,937	0.06
	内　カナダ	85,365,608	0.03
	内　オーストラリア	81,636,190	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		361,453,296,135	98.22
	内　アメリカ	138,300,423,978	37.58
	内　イタリア	38,361,906,867	10.42
	内　フランス	38,309,234,026	10.41
	内　ドイツ	31,263,465,909	8.50
	内　イギリス	30,657,704,303	8.33
	内　スペイン	20,592,100,619	5.60
	内　ベルギー	10,393,990,158	2.82
	内　オランダ	9,901,547,627	2.69
	内　カナダ	8,505,621,059	2.31
	内　オーストラリア	6,277,475,772	1.71
	内　オーストリア	6,071,362,960	1.65
	内　メキシコ	4,007,792,140	1.09
	内　アイルランド	3,039,739,490	0.83
	内　デンマーク	2,922,583,213	0.79
	内　ポーランド	2,364,054,337	0.64
	内　フィンランド	2,341,349,043	0.64
	内　マレーシア	2,030,849,074	0.55
	内　スウェーデン	2,021,296,500	0.55
	内　南アフリカ	1,862,427,546	0.51
	内　シンガポール	1,247,937,179	0.34
	内　ノルウェー	980,434,335	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,534,933,468	1.78
純資産総額		367,988,229,603	100.00

その他資産の投資状況

平成26年8月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		832,556,330	△0.23
	－	832,556,330	△0.23

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（２）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成26年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,675	2,675	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	2,141	2,141	0.8095	0.8095
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,414	2,414	0.8824	0.8824
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,558	2,558	0.9041	0.9041
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,647	2,647	0.9088	0.9088
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	2,911	2,911	1.0079	1.0079
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,332	3,332	1.1304	1.1304
平成25年8月末日	3,041	－	1.0615	－
9月末日	3,167	－	1.0892	－
10月末日	3,192	－	1.1019	－
11月末日	3,333	－	1.1257	－
12月末日	3,362	－	1.1400	－
平成26年1月末日	3,320	－	1.1211	－
2月末日	3,334	－	1.1257	－
3月末日	3,349	－	1.1285	－
4月末日	3,332	－	1.1238	－
5月末日	3,385	－	1.1336	－
6月末日	3,790	－	1.1488	－
7月末日	3,832	－	1.1578	－
8月末日	3,817	－	1.1620	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	4,722	4,722	0.9331	0.9331
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	3,473	3,473	0.6847	0.6847
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	4,138	4,138	0.7770	0.7770
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	4,500	4,500	0.8051	0.8051
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	4,695	4,695	0.7945	0.7945
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	5,529	5,529	0.9153	0.9153
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	6,284	6,284	1.0798	1.0798
平成25年8月末日	5,839	－	0.9894	－
9月末日	6,074	－	1.0291	－
10月末日	6,136	－	1.0429	－
11月末日	6,341	－	1.0773	－
12月末日	6,429	－	1.1010	－
平成26年1月末日	6,245	－	1.0674	－
2月末日	6,277	－	1.0721	－
3月末日	6,284	－	1.0765	－
4月末日	6,221	－	1.0671	－
5月末日	6,355	－	1.0816	－
6月末日	7,050	－	1.1045	－
7月末日	7,111	－	1.1173	－
8月末日	7,075	－	1.1203	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年2月25日)	2,611	2,611	0.8961	0.8961
第2計算期間末 (平成21年2月25日)	1,747	1,747	0.5753	0.5753
第3計算期間末 (平成22年2月25日)	2,234	2,234	0.6792	0.6792
第4計算期間末 (平成23年2月25日)	2,479	2,479	0.7105	0.7105
第5計算期間末 (平成24年2月27日)	2,553	2,553	0.6888	0.6888
第6計算期間末 (平成25年2月25日)	3,149	3,149	0.8234	0.8234
第7計算期間末 (平成26年2月25日)	3,784	3,784	1.0149	1.0149
平成25年8月末日	3,424	－	0.9071	－
9月末日	3,632	－	0.9565	－
10月末日	3,635	－	0.9711	－
11月末日	3,798	－	1.0145	－
12月末日	3,891	－	1.0465	－
平成26年1月末日	3,743	－	1.0000	－
2月末日	3,764	－	1.0048	－
3月末日	3,783	－	1.0108	－
4月末日	3,724	－	0.9974	－
5月末日	3,823	－	1.0157	－
6月末日	4,197	－	1.0451	－
7月末日	4,261	－	1.0612	－
8月末日	4,254	－	1.0632	－

②【分配の推移】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	１口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	１口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	１口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	－

③【収益率の推移】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	△2.9
第2計算期間	△16.6
第3計算期間	9.0
第4計算期間	2.5
第5計算期間	0.5
第6計算期間	10.9
第7計算期間	12.2
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	2.9

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	△6.7
第2計算期間	△26.6
第3計算期間	13.5
第4計算期間	3.6
第5計算期間	△1.3
第6計算期間	15.2
第7計算期間	18.0
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	4.0

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	収益率(%)
第1計算期間	△10.4
第2計算期間	△35.8
第3計算期間	18.1
第4計算期間	4.6
第5計算期間	△3.1
第6計算期間	19.5
第7計算期間	23.3
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	5.2

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

２【設定及び解約の実績】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,100,768,537	345,452,038
第2計算期間	229,578,698	339,107,428
第3計算期間	243,751,371	153,541,357
第4計算期間	235,972,752	141,593,022
第5計算期間	285,646,931	203,029,716
第6計算期間	225,648,685	250,182,940
第7計算期間	462,391,895	402,339,311
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	428,986,168	106,853,422

（注1）　本邦外における設定及び解約はございません。
（注2）　設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,407,868,136	346,621,435
第2計算期間	439,067,605	427,745,782
第3計算期間	495,694,818	241,797,536
第4計算期間	487,922,998	224,206,853
第5計算期間	613,641,679	293,757,615
第6計算期間	463,334,274	332,253,908
第7計算期間	634,765,225	855,483,167
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	699,071,880	231,627,637

（注1）　本邦外における設定及び解約はございません。
（注2）　設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,243,343,171	329,317,247
第2計算期間	362,375,624	238,812,098
第3計算期間	443,121,260	190,773,589
第4計算期間	402,406,730	203,211,017
第5計算期間	407,822,179	190,193,682
第6計算期間	402,795,344	284,007,685
第7計算期間	570,595,111	667,503,750
平成26年2月26日～ 平成26年8月25日	435,322,123	181,748,779

（注1）　本邦外における設定及び解約はございません。
（注2）　設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

３【ファンドの経理状況】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年2月26日から平成26年8月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,531,349	119,212,405
親投資信託受益証券	3,233,554,296	3,691,242,281
未収入金	－	2,758,000
流動資産合計	3,337,085,645	3,813,212,686
資産合計	3,337,085,645	3,813,212,686
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,377	4,269,629
未払受託者報酬	510,683	557,971
未払委託者報酬	3,575,017	3,906,061
その他未払費用	80,775	88,269
流動負債合計	4,167,852	8,821,930
負債合計	4,167,852	8,821,930
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,948,513,057	※1 3,270,645,803
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	384,404,736	533,744,953
（分配準備積立金）	455,351,726	440,108,491
元本等合計	3,332,917,793	3,804,390,756
純資産合計	3,332,917,793	3,804,390,756
負債純資産合計	3,337,085,645	3,813,212,686

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月25日	第8期中間計算期間 自　平成26年2月26日 至　平成26年8月25日
営業収益		
受取利息	29,980	30,811
有価証券売買等損益	181,453,023	107,191,985
営業収益合計	181,483,003	107,222,796
営業費用		
受託者報酬	468,934	557,971
委託者報酬	3,282,817	3,906,061
その他費用	74,171	88,269
営業費用合計	3,825,922	4,552,301
営業利益又は営業損失（△）	177,657,081	102,670,495
経常利益又は経常損失（△）	177,657,081	102,670,495
中間純利益又は中間純損失（△）	177,657,081	102,670,495
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	11,149,134	1,211,326
期首剰余金又は期首欠損金（△）	22,733,238	384,404,736
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,292,355	61,909,837
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,292,355	61,909,837
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,975,074	14,028,789
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,975,074	14,028,789
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	196,558,466	533,744,953

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目			第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．	※１	期首元本額	2,888,460,473円	2,948,513,057円
		期中追加設定元本額	462,391,895円	428,986,168円
		期中一部解約元本額	402,339,311円	106,853,422円
２．		受益権の総数	2,948,513,057口	3,270,645,803口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1304円 (11,304円)	1.1632円 (11,632円)

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年2月26日から平成26年8月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	189,979,490	220,413,851
親投資信託受益証券	6,104,091,365	6,854,147,493
未収入金	－	14,752,000
流動資産合計	6,294,070,855	7,089,313,344
資産合計	6,294,070,855	7,089,313,344
負債の部		
流動負債		
未払解約金	502,980	16,733,318
未払受託者報酬	976,206	1,042,587
未払委託者報酬	7,809,967	8,341,028
その他未払費用	154,475	164,998
流動負債合計	9,443,628	26,281,931
負債合計	9,443,628	26,281,931
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,820,428,439	※1 6,287,872,682
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	464,198,788	775,158,731
（分配準備積立金）	964,520,597	928,706,646
元本等合計	6,284,627,227	7,063,031,413
純資産合計	6,284,627,227	7,063,031,413
負債純資産合計	6,294,070,855	7,089,313,344

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月25日	第8期中間計算期間 自　平成26年2月26日 至　平成26年8月25日
営業収益		
受取利息	57,750	57,563
有価証券売買等損益	542,600,564	274,469,128
営業収益合計	542,658,314	274,526,691
営業費用		
受託者報酬	910,628	1,042,587
委託者報酬	7,285,359	8,341,028
その他費用	144,101	164,998
営業費用合計	8,340,088	9,548,613
営業利益又は営業損失（△）	534,318,226	264,978,078
経常利益又は経常損失（△）	534,318,226	264,978,078
中間純利益又は中間純損失（△）	534,318,226	264,978,078
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	38,121,539	2,992,423
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△511,600,174	464,198,788
剰余金増加額又は欠損金減少額	38,891,011	67,678,054
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	38,891,011	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	67,678,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,734,737	18,703,766
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	18,703,766
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,734,737	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	18,752,787	775,158,731

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目		第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．　※１	期首元本額	6,041,146,381円	5,820,428,439円
	期中追加設定元本額	634,765,225円	699,071,880円
	期中一部解約元本額	855,483,167円	231,627,637円
２．	受益権の総数	5,820,428,439口	6,287,872,682口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0798円 (10,798円)	1.1233円 (11,233円)

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成26年2月26日から平成26年8月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	117,607,933	132,377,116
親投資信託受益証券	3,673,086,670	4,126,811,946
未収入金	560,000	10,885,000
流動資産合計	3,791,254,603	4,270,074,062
資産合計	3,791,254,603	4,270,074,062
負債の部		
流動負債		
未払解約金	978,441	11,836,343
未払受託者報酬	583,130	624,604
未払委託者報酬	5,248,581	5,621,848
その他未払費用	92,253	98,826
流動負債合計	6,902,405	18,181,621
負債合計	6,902,405	18,181,621
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,728,640,351	※1 3,982,213,695
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	55,711,847	269,678,746
（分配準備積立金）	620,801,638	592,014,305
元本等合計	3,784,352,198	4,251,892,441
純資産合計	3,784,352,198	4,251,892,441
負債純資産合計	3,791,254,603	4,270,074,062

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自　平成25年2月26日 至　平成25年8月25日	第8期中間計算期間 自　平成26年2月26日 至　平成26年8月25日
営業収益		
受取利息	34,153	34,700
有価証券売買等損益	402,095,278	210,687,276
営業収益合計	402,129,431	210,721,976
営業費用		
受託者報酬	532,313	624,604
委託者報酬	4,791,150	5,621,848
その他費用	84,198	98,826
営業費用合計	5,407,661	6,345,278
営業利益又は営業損失（△）	396,721,770	204,376,698
経常利益又は経常損失（△）	396,721,770	204,376,698
中間純利益又は中間純損失（△）	396,721,770	204,376,698
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	34,768,941	2,253,965
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△675,757,307	55,711,847
剰余金増加額又は欠損金減少額	61,034,261	14,657,155
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	61,034,261	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	14,657,155
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,956,158	2,812,989
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	2,812,989
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,956,158	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△277,726,375	269,678,746

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目			第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．	※１	期首元本額	3,825,548,990円	3,728,640,351円
		期中追加設定元本額	570,595,111円	435,322,123円
		期中一部解約元本額	667,503,750円	181,748,779円
２．		受益権の総数	3,728,640,351口	3,982,213,695口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 平成26年2月25日現在	第8期中間計算期間末 平成26年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0149円 (10,149円)	1.0677円 (10,677円)

（参考）

「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		11,300,638,260	3,317,154,799
株式	※２	312,658,405,390	318,469,257,650
派生商品評価勘定		280,076,705	80,925,056
未収入金		－	14,355,000
未収配当金		296,589,336	225,245,895
差入委託証拠金		222,510,905	－
流動資産合計		324,758,220,596	322,106,938,400
資産合計		324,758,220,596	322,106,938,400
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		154,187,644	－
前受金		276,030,905	69,488,000
未払金		1,908,676	－
未払解約金		90,566,000	227,893,000
流動負債合計		522,693,225	297,381,000
負債合計		522,693,225	297,381,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	188,809,272,100	176,985,806,430
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		135,426,255,271	144,823,750,970
元本等合計		324,235,527,371	321,809,557,400
純資産合計		324,235,527,371	321,809,557,400
負債純資産合計		324,758,220,596	322,106,938,400

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	228,600,317,852円	188,809,272,100円
同期中追加設定元本額	38,039,433,917円	11,740,162,935円
同期中一部解約元本額	77,830,479,669円	23,563,628,605円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	4,033,737,176円	4,075,675,615円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	1,372,061,781円	1,311,937,046円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	37,734,354,972円	37,187,647,281円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	757,481,705円	788,151,664円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,859,610,081円	2,926,004,762円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,039,958,422円	3,119,629,533円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	386,095,927円	420,058,626円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,267,213,606円	1,361,943,886円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,088,127,674円	1,169,574,306円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	111,502,908円	102,044,314円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,364,450,473円	1,318,823,152円

マネックス資産設計ファンドエボリューション	20,448,323円	23,773,008円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	8,307,168円	14,121,129円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	11,558,016円	25,375,008円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	27,609,029円	57,309,254円
投資のソムリエ	120,681,929円	174,786,898円
クルーズコントロール	21,759,643円	456,153,585円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	545,733円	3,868,094円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	580,728円	12,519,104円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	－円	110,157円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,568,450円	143,440,310円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,890,060,568円	3,507,726,822円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	965,282,970円	771,524,530円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	123,456,284円	94,257,167円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	412,806,035円	358,074,097円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	109,050,843円	90,030,155円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	181,178,060円	146,802,704円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,929,403,132円	13,637,762,713円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,948,236,931円	4,490,429,478円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,568,706,610円	3,302,382,209円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,412,090,211円	2,203,254,728円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,811,787,943円	5,383,027,753円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	674,290,940円	541,903,147円

ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	1,720,122,396円	1,439,787,330円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,580,270,828円	1,393,172,742円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	8,198,833,798円	6,901,394,373円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	87,280,606円	93,432,732円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,029,796,482円	2,653,222,686円	
ＤＩＡＭアイエヌジー世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,515,993,196円	7,082,264,454円	
ＤＩＡＭグローバル分散ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	291,570,512円	246,606,852円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,248,047,481円	26,220,651,171円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,430,352,903円	1,208,826,897円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,349,426,242円	3,034,374,743円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,435,869,317円	16,279,682,621円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,639,429円	40,833円	
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	84,011,222円	95,324,341円	
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	85,761,418円	52,573,761円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,490,002,989円	14,486,875,762円	
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	191,093,460円	136,729,563円	
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,997,307円	49,588,239円	
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,532,453円	58,264,737円	
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	84,697円	92,779,126円	
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	126,520円	125,875円	

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	935,035,848円	900,296,115円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	2,351,917,037円	2,273,472,480円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	3,056,002,530円	2,945,619,832円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	124,499,158円	120,576,930円
計	188,809,272,100円	176,985,806,430円
２．　受益権の総数	188,809,272,100口	176,985,806,430口
３．　※２　差入代用有価証券	株式　2,995,000,000円	株式　2,992,500,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成26年8月25日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	11,384,830,000	－	11,511,045,000	126,215,000	3,230,352,000	－	3,311,360,000	81,008,000
合計	11,384,830,000	－	11,511,045,000	126,215,000	3,230,352,000	－	3,311,360,000	81,008,000

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7173円 (17,173円)	1.8183円 (18,183円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,583,323,975	3,894,154,262
国債証券		351,275,841,100	348,960,359,900
地方債証券		28,762,321,767	28,910,896,498
特殊債券		29,885,012,244	29,040,151,098
社債券		27,524,696,780	24,282,922,160
未収利息		1,589,417,351	1,557,299,724
前払費用		35,039,973	26,608,048
流動資産合計		441,655,653,190	436,672,391,690
資産合計		441,655,653,190	436,672,391,690
負債の部			
流動負債			
未払解約金		114,210,000	113,384,000
流動負債合計		114,210,000	113,384,000
負債合計		114,210,000	113,384,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	369,629,287,107	362,155,775,392
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		71,912,156,083	74,403,232,298
元本等合計		441,541,443,190	436,559,007,690
純資産合計		441,541,443,190	436,559,007,690
負債純資産合計		441,655,653,190	436,672,391,690

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	379,645,534,947円	369,629,287,107円
同期中追加設定元本額	68,533,693,970円	18,005,753,151円
同期中一部解約元本額	78,549,941,810円	25,479,264,866円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	6,124,799,820円	7,808,007,971円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	9,964,889,255円	10,342,860,236円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	3,689,890,795円	4,032,867,486円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	5,899,835,145円	6,294,810,810円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,441,051,268円	2,565,883,480円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,445,723,290円	1,631,606,629円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,576,398,413円	1,741,944,773円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	223,891,406円	245,169,858円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	155,827,199円	159,468,075円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,914,949,486円	2,059,946,942円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	3,450,420円	4,856,626円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	65,611,552円	120,128,125円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	32,831,575円	79,231,776円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	9,744,053円	21,605,494円
投資のソムリエ	572,926,042円	858,681,755円
クルーズコントロール	41,067,151円	839,485,208円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	2,528,769円	19,002,870円

ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	4,868,709円	107,596,177円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	－円	91,454円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
ＤＩＡＭ高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	12,480,682,698円	12,468,178,363円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	729,182,367円	711,685,357円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,371,525,368円	6,354,208,492円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	550,031,413円	465,570,855円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	410,802,331円	332,088,028円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	883,135,350円	810,867,526円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	389,296,695円	339,881,813円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	344,472,009円	295,456,268円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,933,620,345円	30,884,366,052円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,587,775,823円	10,168,827,157円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,576,802,100円	13,298,525,351円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,159,581,547円	4,989,420,317円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,286,523,508円	8,125,694,830円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	1,453,753,657円	1,226,721,448円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	6,149,349,161円	5,430,714,625円

ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,772,700,939円	6,321,262,461円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	11,688,869,273円	10,418,623,450円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	508,585,424円	492,774,489円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,047,452,258円	12,053,443,925円
ＤＩＡＭアイエヌジー世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,305,551,020円	8,330,542,690円
ＤＩＡＭグローバル分散ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,356,918,135円	1,223,878,085円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,438,352,199円	105,567,596,911円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,039,450,561円	1,824,679,091円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,556,849,896円	9,164,071,724円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,152,430,550円	32,767,276,197円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	167,899,806円	488,946円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	299,556,566円	360,170,422円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,282,533円	79,447,922円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,823,253,663円	36,455,026,010円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	896,638,916円	678,525,569円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	192,913,809円	174,685,318円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,752,178,041円	886,492,604円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	423,568円	491,161,087円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	300,391円	315,425円
計	369,629,287,107円	362,155,775,392円
２．　受益権の総数	369,629,287,107口	362,155,775,392口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1946円 (11,946円)	1.2054円 (12,054円)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		7,238,506,876	2,229,119,671
コール・ローン		95,423,713	217,310,284
株式		301,789,773,803	300,521,929,910
投資信託受益証券		872,653,837	953,241,543
投資証券		5,370,362,315	5,975,504,433
派生商品評価勘定		187,898,027	38,785,964
未収配当金		823,647,139	624,761,967
差入委託証拠金		1,697,116,653	1,203,011,560
流動資産合計		318,075,382,363	311,763,665,332
資産合計		318,075,382,363	311,763,665,332
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		262,500	20,163,459
未払解約金		501,256,000	276,293,000
流動負債合計		501,518,500	296,456,459
負債合計		501,518,500	296,456,459
純資産の部			
元本等			
元本	※１	137,116,704,251	125,462,250,959
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		180,457,159,612	186,004,957,914
元本等合計		317,573,863,863	311,467,208,873
純資産合計		317,573,863,863	311,467,208,873
負債純資産合計		318,075,382,363	311,763,665,332

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	182,478,399,692円	137,116,704,251円
同期中追加設定元本額	14,598,144,822円	4,075,937,769円
同期中一部解約元本額	59,959,840,263円	15,730,391,061円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	1,157,227,895円	893,909,112円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,333,122,557円	34,068,847,314円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	146,968,029円	153,916,575円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	869,514,428円	866,753,421円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,108,459,293円	1,092,708,637円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	147,409,276円	155,318,957円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	416,887,340円	431,204,266円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	335,873,826円	345,016,056円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	77,685,053円	65,315,997円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	952,637,609円	844,044,486円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	176,632,962円	183,443,058円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	6,128,891円	10,525,129円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	8,519,657円	18,667,888円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	20,501,667円	42,131,104円
投資のソムリエ	89,302,448円	129,275,420円
クルーズコントロール	8,482,513円	167,428,587円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	398,539円	2,861,274円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	454,098円	9,329,317円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	－円	38,768円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	445,997,136円	417,260,107円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	4,220,261,501円	3,968,374,136円

ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,901,162円	45,532,824円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,735,475,008円	2,600,161,741円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	737,284,160円	571,747,055円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	94,323,154円	69,869,356円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	467,749,117円	398,105,430円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	41,625,205円	33,333,036円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,263,536円	72,528,366円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,371,122,917円	10,109,317,122円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,671,731,149円	4,993,726,822円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,813,277,510円	1,622,971,691円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,607,532,960円	1,428,951,731円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,422,388,362円	3,990,377,782円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	2,618,996,253円	2,003,955,447円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	3,998,591,953円	3,191,093,297円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,375,814,024円	2,068,392,777円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	2,069,110,615円	1,691,529,369円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	27,678,338円	28,088,225円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,587,917,377円	8,863,616,317円

ＤＩＡＭアイエヌジー世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,237,421,615円	2,105,479,917円
ＤＩＡＭグローバル分散ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	72,249,171円	61,063,411円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,346,736,140円	12,956,037,595円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,085,199,207円	893,970,402円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,555,117,327円	2,249,244,219円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,859,175,681円	8,044,107,594円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,611,889円	150,287円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	257,732,938円	283,347,522円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	240,880,538円	142,295,539円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,814,829,536円	10,738,576,724円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	284,017,847円	131,635,964円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	194,209円	206,394,323円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	290,635円	279,465円
計	137,116,704,251円	125,462,250,959円
２．　受益権の総数	137,116,704,251口	125,462,250,959口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成26年8月25日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	5,236,927,180	－	5,236,634,000	293,180	1,071,844,860	－	1,071,873,000	△28,140
アメリカ・ドル	3,138,079,860	－	3,137,724,000	355,860	666,693,660	－	666,752,000	△58,340
イギリス・ポンド	546,447,450	－	546,496,000	△48,550	120,732,850	－	120,729,000	3,850
オーストラリア・ドル	222,176,400	－	222,290,000	△113,600	58,102,500	－	58,142,000	△39,500
カナダ・ドル	231,588,000	－	231,650,000	△62,000	47,502,250	－	47,500,000	2,250
ユーロ	1,098,635,470	－	1,098,474,000	161,470	178,813,600	－	178,750,000	63,600
合計	5,236,927,180	－	5,236,634,000	293,180	1,071,844,860	－	1,071,873,000	△28,140

（注）時価の算定方法

１．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

２．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成26年8月25日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
先物取引								
買　建	4,084,177,311	－	4,271,519,658	187,342,347	2,908,781,427	－	2,927,432,072	18,650,645
合計	4,084,177,311	－	4,271,519,658	187,342,347	2,908,781,427	－	2,927,432,072	18,650,645

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3161円 (23,161円)	2.4826円 (24,826円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,003,458,961	4,714,184,996
コール・ローン		225,302,330	376,670,885
国債証券		375,243,989,904	360,866,057,496
派生商品評価勘定		13,817	1,687,837
未収入金		－	1,066,073,007
未収利息		4,017,527,019	3,530,150,104
前払費用		141,576,037	131,416,067
流動資産合計		384,631,868,068	370,686,240,392
資産合計		384,631,868,068	370,686,240,392
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	360,469
未払解約金		62,372,000	911,755,000
流動負債合計		62,372,000	912,115,469
負債合計		62,372,000	912,115,469
純資産の部			
元本等			
元本	※１	234,028,916,867	215,780,472,885
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		150,540,579,201	153,993,652,038
元本等合計		384,569,496,068	369,774,124,923
純資産合計		384,569,496,068	369,774,124,923
負債純資産合計		384,631,868,068	370,686,240,392

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　※１　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	280,556,875,822円	234,028,916,867円
同期中追加設定元本額	17,179,528,256円	6,681,059,968円
同期中一部解約元本額	63,707,487,211円	24,929,503,950円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	3,042,808,840円	3,449,346,856円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,215,730,642円	4,410,650,160円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	331,588,356円	354,938,274円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,211,540,212円	1,252,957,854円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,303,541,985円	1,325,826,787円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	305,504,835円	335,599,119円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	656,719,484円	704,602,315円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	461,916,251円	494,900,146円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	45,079,861円	41,206,424円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	545,649,215円	533,019,227円

マネックス資産設計ファンドエボリューション	8,202,426円	9,738,094円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	2,492,699円	4,486,615円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	3,064,251円	7,196,026円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	7,073,170円	15,206,693円	
クルーズコントロール	30,350,803円	603,222,308円	
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	186,505円	4,055,721円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	－円	47,327円	
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	3,440,686,045円	2,995,426,859円	
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,268,094,899円	6,200,912,339円	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	4,910,796,362円	5,160,744,485円	
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	1,256,699,172円	1,254,471,751円	
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	162,201,386円	154,067,477円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,485,399,797円	18,076,562,666円	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,609,853,495円	1,327,305,216円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	300,395,823円	236,572,141円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	430,402,346円	384,923,781円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	113,653,304円	96,705,375円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	62,920,414円	52,576,679円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,349,328,976円	21,951,585,938円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,158,609,726円	4,828,541,073円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,685,291,057円	8,203,461,504円	

	ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,087,051,309円	3,849,703,361円
	ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,058,907,931円	5,784,604,608円
	ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	1,772,289,243円	1,445,497,488円
	ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	6,291,716,856円	5,414,300,052円
	ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,633,814,428円	6,014,304,782円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	31,608,060,489円	27,154,813,025円
	ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	104,311,492円	107,414,303円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,753,049,113円	4,271,900,516円
	ＤＩＡＭアイエヌジー世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,764,142,018円	13,397,614,881円
	ＤＩＡＭグローバル分散ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	202,690,780円	174,623,653円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,631,763,420円	18,730,333,453円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,240,319,192円	23,318,934,663円
	ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	45,970,194円	131,187円
	ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	219,032,482円	256,579,254円
	ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	89,231,077円	55,923,576円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,537,285,269円	20,749,157,783円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	199,262,536円	146,993,494円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	383,883,760円	189,076,997円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	221,510円	247,573,549円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	131,431円	135,030円
計		234,028,916,867円	215,780,472,885円

２．　受益権の総数	**234,028,916,867口**	**215,780,472,885口**

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成26年2月25日 現在				平成26年8月25日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	237,312,367	－	237,298,550	13,817	2,083,374,678	－	2,082,047,310	1,327,368
アメリカ・ドル	－	－	－	－	692,126,274	－	692,380,280	△254,006
イギリス・ポンド	－	－	－	－	275,788,324	－	275,779,530	8,794
カナダ・ドル	－	－	－	－	141,015,600	－	141,075,000	△59,400
ユーロ	237,312,367	－	237,298,550	13,817	974,444,480	－	972,812,500	1,631,980
合計	237,312,367	－	237,298,550	13,817	2,083,374,678	－	2,082,047,310	1,327,368

（注）時価の算定方法

１．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

２．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成26年2月25日現在	平成26年8月25日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6433円 (16,433円)	1.7137円 (17,137円)

４【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

本書提出日現在の資本金の額　　20億円
発行する株式総数　　80,000株
発行済株式総数　　24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動
該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。
平成26年8月29日現在、委託会社の運用する投資信託は336本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 （単位：円）
単位型株式投資信託	7	20,451,452,315
追加型株式投資信託	314	5,177,824,775,272
単位型公社債投資信託	15	150,909,870,559
追加型公社債投資信託	0	0
合計	336	5,349,186,098,146

（３）【その他】

(1) 定款の変更等
平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。
・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

(2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

５【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第28期 （平成25年3月31日現在）		第29期 （平成26年3月31日現在）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		10,806,745		11,487,360
金銭の信託		10,214,440		10,952,459
前払費用		69,143		64,554
未収委託者報酬		3,073,481		3,854,410
未収運用受託報酬		1,173,744		1,415,502
未収投資助言報酬	※2	245,819	※2	255,218
未収収益		244,974		275,082
繰延税金資産		426,229		401,327
その他		25,354		23,246
流動資産計		26,279,933		28,729,163
固定資産				
有形固定資産		378,530		293,329
建物	※1	142,820	※1	122,181
車両運搬具	※1	2,770	※1	1,615
器具備品	※1	231,732	※1	140,023
建設仮勘定		1,207		29,509
無形固定資産		1,337,985		1,838,855
商標権	※1	289	※1	195
ソフトウエア	※1	1,261,335	※1	1,188,444
ソフトウエア仮勘定		68,920		642,834
電話加入権		7,148		7,148
電信電話専用施設利用権	※1	292	※1	231
投資その他の資産		4,002,042		4,178,284
投資有価証券		400,579		617,159
関係会社株式		2,119,074		2,119,074
繰延税金資産		661,777		622,698
差入保証金		731,564		731,197
その他		89,047		88,154
固定資産計		5,718,557		6,310,469
資産合計		31,998,491		35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	―
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	※2 1,306,837	※2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第28期 （自　平成24年4月 1日 至　平成25年3月31日）		第29期 （自　平成25年4月 1日 至　平成26年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期 （自　平成24年4月 1日 至　平成25年3月31日）		第29期 （自　平成25年4月 1日 至　平成26年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		―	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	―		213,744	
雑損失	―		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	※1　1,752		※1　22	
固定資産売却損	※2　115		※2　1,448	
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		△ 134,463		△ 13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

（３）【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
				別途積立金	研究開発積立金	運用責任準備積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の配当							△2,712,000	△2,712,000	△2,712,000
別途積立金の積立				700,000			△700,000	－	－
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	700,000	－	－	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の配当		△2,712,000
別途積立金の積立		－
当期純利益		3,894,102
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△32,375	△32,375
当期変動額合計	△32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
				別途積立金	研究開発積立金	運用責任準備積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							△3,096,000	△3,096,000	△3,096,000
別途積立金の積立				800,000			△800,000	－	－
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	800,000	－	－	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		△3,096,000
別途積立金の積立		－
当期純利益		4,686,047
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期　（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）
「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日） （1）概要 財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。 （2）適用予定日 退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。 （3）当該会計基準等の適用による影響 退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウエア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

※2．関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

		第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

（損益計算書関係）

※1．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
器具備品	―	22
ソフトウエア	1,752	0

※2．固定資産売却損の内訳

（千円）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
器具備品	115	1,448

（株主資本等変動計算書関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	―	―	24,000
合計	24,000	―	―	24,000

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日定時株主総会	普通株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首株式数（株）	当事業年度増加株式数（株）	当事業年度減少株式数（株）	当事業年度末株式数（株）
普通株式	24,000	－	－	24,000
合計	24,000	－	－	24,000

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日定時株主総会	普通株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成26年6月30日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第28期（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	10,806,745	10,806,745	―
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	320,332	320,332	―
資産計	21,341,518	21,341,518	―
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	―
負債計	1,299,068	1,299,068	―

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	―
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	536,913	536,913	―
資産計	22,976,732	22,976,732	―
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	―
負債計	1,721,861	1,721,861	―

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負　債

（1）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
①非上場株式	80,246	80,246
②関係会社株式	2,119,074	2,119,074
③差入保証金	731,564	731,197

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

③差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期（平成25年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	10,806,412	－	－	－
合計	10,806,412	－	－	－

第29期（平成26年3月31日現在）

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	11,486,870	－	－	－
合計	11,486,870	－	－	－

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券
該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（第28期及び第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4．その他有価証券
第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

区　分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	307,639	146,101	161,537
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	8,688	10,000	△1,312
小計	8,688	10,000	△1,312
合計	320,332	159,101	161,231

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区　分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
①株式	522,887	146,101	376,785
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②債券	―	―	―
③その他（投資信託）	9,474	10,000	△526
小計	9,474	10,000	△526
合計	536,913	159,101	377,811

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期　（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,214,440	946,377

第29期　（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要
当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

（1）　退職給付債務	936,125
（2）　未認識数理計算上の差異	△133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

（1） 勤務費用	102,125
（2） 利息費用	11,108
（3） 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
（4） 確定拠出年金　拠出額	41,923
（5） その他	314
退職給付費用	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）割引率

1.5%

（2）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

（3）数理計算上の差異の処理年数

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	△34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	（千円）
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	△112,660
未認識過去勤務費用	△19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	（千円）
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	－
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	－
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	－	54,172
繰延税金負債合計	－	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。
この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（セグメント情報等）

１．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

２．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

②有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

①営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

②有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名，出向2名，転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	710,289	未収投資助言報酬	203,114

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	2,102億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名，出向2名，転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	801,412	未収投資助言報酬	212,159

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	520,967	未払費用	175,664
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	214,290	未払費用	89,815

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	627,855	未払費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	251,110	未払費用	97,587

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	1,661,638	未払手数料	142,323
								預金の預入（純額）	191,782	現金・預金	625,561
								受取利息	106	未収収益	-
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	460,605	未払手数料	100,875
								預金の引出（純額）	1,912,442	現金・預金	9,527,582
								受取利息	3,210	未収収益	61
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	―	―	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	259,435	未払費用	132,250
								業務委託料の支払	11,140	未払費用	5,848
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	―	―	当社信託財産の運用	信託元本の追加（純額）	3,500,000	金銭の信託	10,214,440
								信託報酬の支払	5,908		

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行(旧株式会社みずほコーポレート銀行)	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料 預金の預入（純額） 受取利息	1,629,874 775,579 2,073	未払手数料 現金・預金 未収収益	224,525 10,724,847 12
	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	7,000億円	銀行業	－	－	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料 預金の引出（純額）	432,201 203,876	－	－
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	－	－	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払 業務委託料の支払	287,136 11,810	未払費用 未払金	155,413 2,646
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	－	－	当社信託財産の運用	信託元本の追加（純額） 信託報酬の支払	1,000,000 7,933	金銭の信託	10,952,459

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成２６年６月６日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山内　正彦　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　浅野　　功　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　近藤　敏弘　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２５年４月１日から平成２６年３月３１日までの第２９期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社の平成２６年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２６年１０月８日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木　貴司　印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　和　田　　渉　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンドの平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンドの平成２６年８月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

※　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

※　ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２６年１０月８日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木　貴司　印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　和　田　　渉　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンドの平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンドの平成２６年８月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

※　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

※　ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成２６年１０月８日

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木　貴司　印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　和　田　　渉　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンドの平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンドの平成２６年８月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成２６年２月２６日から平成２６年８月２５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

※　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

※　ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。